

Nama : Doni Agus Setiawan  
NIM : 96 . 60 . 0393  
Nirm : 96 . 6 . 111 . 02030 . 50105  
Jurusan : Akuntansi  
Dosen Pembimbing : Drs. H. Hudi Prawoto, MM, Akt  
Judul Skripsi : Analisis Variabel – Variabel Yang Mempengaruhi Return  
Saham Perusahaan Perbankan di PT. Bursa Efek Jakarta



## ABSTRAKSI

Industri perbankan adalah salah satu industri yang ikut berperan serta dalam pasar modal, disamping industri lainnya seperti industri manufaktur pertanian, pertambangan, property dan lain – lain. Industri perbankan adalah industri yang paling sensitive atau rentan terhadap keadaan luar. Dalam krisis ekonomi di Indonesia, Industri perbankan dan property mengalami penurunan tingkat Return sahamnya yang sangat drastis, penurunannya melebihi dari industri lainnya.

Penelitian ini dilakukan untuk mengetahui seberapa besar tingkat Return saham pada perusahaan perbankan di Bursa Efek Jakarta dan meneliti variabel – variabel yang mempengaruhi terhadap Return saham tersebut. Variabel yang digunakan dalam penelitian ini adalah Earning Per Share, Return on Equity, Return on Assets, Net Profit Margin, Loan to Deposit Ratio, Debt to Equity Ratio, Current Ratio, Capital Adequacy Ratio yang mewakili variabel independen sedangkan variabel dependennya diwakili oleh Return Saham.

Hasil pengujian dengan menggunakan regresi linier berganda menunjukkan ada dua variabel ternyata berpengaruh secara signifikan yaitu EPS dan ROE yang dilihat secara parsial terhadap return saham sedangkan secara simultan terdapat enam variabel yang mempunyai pengaruh signifikan terhadap Return saham yaitu EPS, ROE, LDR, DER, CR, CAR dan dapat dilihat juga variabel yang paling dominan berpengaruh terhadap return saham yaitu ROE. Serta berapa persentase pengaruh semua variabel terhadap return saham.

Dengan demikian bisa memberikan masukan bagi investor dalam pengambilan keputusan investasi yang sekiranya perlu memperhatikan Variabel – variabel pada faktor fundamental.